

# ROC Reversal EA - Manuel d'utilisation

## Table des matières

1. [Introduction](#)
2. [Stratégie](#)
3. [Installation](#)
4. [Paramètres](#)
5. [Utilisation](#)
6. [Gestion des risques](#)
7. [Optimisation](#)
8. [Avertissements](#)

## Introduction

**ROC Reversal EA** est un Expert Advisor automatisé pour MetaTrader 5 qui utilise l'indicateur Rate of Change (ROC) pour identifier les retournements de momentum et générer des signaux de trading.

## Caractéristiques principales

- Stratégie basée sur les retournements d'élan (momentum reversal)
- Filtre de tendance avec EMA 100
- Gestion automatique des stop-loss et take-profit
- Trailing stop après 1R de profit
- Compatible avec tous les timeframes (optimisé pour H1)
- Magic Number : **700041**

## Stratégie

### Principe de base

La stratégie ROC Reversal exploite les mouvements extrêmes du Rate of Change pour capturer les retournements de prix après des mouvements de momentum excessifs.

### Rate of Change (ROC)

Le ROC mesure le pourcentage de variation du prix sur une période donnée :

$ROC = ((Prix actuel - Prix il y a N périodes) / Prix il y a N périodes) \times 100$

## Conditions d'entrée

### Position longue (ACHAT)

1. **Condition préalable** : ROC(12) tombe en dessous de -2% (momentum négatif extrême)
2. **Signal d'entrée** : ROC commence à remonter ( $ROC[0] > ROC[1]$ ) et devient positif
3. **Filtre de tendance** (optionnel) : Prix au-dessus de l'EMA 100

### Position courte (VENTE)

1. **Condition préalable** : ROC(12) monte au-dessus de +2% (momentum positif extrême)
2. **Signal d'entrée** : ROC commence à baisser ( $ROC[0] < ROC[1]$ ) et devient négatif
3. **Filtre de tendance** (optionnel) : Prix en dessous de l'EMA 100

## Gestion des positions

### Stop Loss

- **Distance** :  $2,5 \times ATR(14)$
- **Placement** : Automatique à l'ouverture de la position

### Take Profit

- **Condition** : ROC retourne vers zéro (entre -0,5% et +0,5%)
- **Logique** : Le momentum se normalise, signal de sortie

### Trailing Stop

- **Activation** : Après 1R de profit (1 fois la distance du stop loss initial)
- **Niveau** : Prix d'entrée +  $0,5 \times ATR$  pour les longs
- **Niveau** : Prix d'entrée -  $0,5 \times ATR$  pour les courts

## Installation

### Prérequis

- MetaTrader 5 (version récente recommandée)
- Compte de trading avec accès aux données historiques H1
- Connexion internet stable

### Étapes d'installation

1. **Téléchargement** : Copiez le fichier ROCReversalEA.mq5 dans le dossier :

## 2. Compilation :

- Ouvrez MetaEditor (F4 dans MT5)
- Ouvrez le fichier ROCReversalEA.mq5
- Compilez avec F7
- Vérifiez l'absence d'erreurs

## 3. Activation :

- Redémarrez MetaTrader 5
- Glissez-déposez l'EA sur le graphique souhaité
- Configurez les paramètres
- Activez le trading automatique

# Paramètres

## Paramètres de stratégie

Paramètre	Valeur par défaut	Description
<b>ROC_Period</b>	12	Période de calcul du Rate of Change
<b>ROC_Threshold</b>	2.0	Seuil d'extrême en pourcentage ( $\pm 2\%$ )
<b>EMA_Period</b>	100	Période de l'EMA pour le filtre de tendance
<b>ATR_Period</b>	14	Période de calcul de l'ATR
<b>ATR_Multiplier</b>	2.5	Multiplicateur ATR pour le stop loss
<b>UseEMAFilter</b>	true	Activer/désactiver le filtre EMA
<b>UseTrailingStop</b>	true	Activer/désactiver le trailing stop

## Gestion des risques

Paramètre	Valeur par défaut	Description
<b>LotSize</b>	0.1	Taille de position fixe
<b>MaxSpread</b>	3.0	Spread maximum autorisé (points)
<b>Slippage</b>	3	Glissement maximum autorisé

## Paramètres généraux

Paramètre	Valeur par défaut	Description
<b>MagicNumber</b>	700041	Numéro magique unique
<b>EAComent</b>	“ROC Reversal EA”	Commentaire des ordres

# Utilisation

## Configuration recommandée

- **Paire** : EURUSD (par défaut)
- **Timeframe** : H1 (optimisé)
- **Spread** : < 3 points
- **Période de test** : Minimum 3 mois de données historiques

## Étapes de mise en œuvre

1. **Test en démo** :
  - Testez d'abord sur un compte de démonstration
  - Vérifiez les performances sur 1-3 mois
  - Analysez le drawdown maximum
2. **Optimisation** :
  - Utilisez le testeur de stratégies de MT5
  - Optimisez sur 1 an de données historiques
  - Validez sur une période différente
3. **Mise en production** :
  - Commencez avec une taille de position réduite
  - Surveillez quotidiennement les premiers trades
  - Ajustez les paramètres si nécessaire

## Monitoring

- **Vérifiez quotidiennement** : Position ouverte, P&L
- **Hebdomadairement** : Performance globale, drawdown
- **Mensuellement** : Ratio de réussite, profit factor

## Gestion des risques

### Règles de base

1. **Ne jamais risquer plus de 2% du capital par trade**
2. **Diversifier les paires si possible**
3. **Arrêter l'EA en cas de news importantes**
4. **Surveiller le drawdown maximum**

## Calcul de la taille de position

Taille lot = (Capital × Risque%) / (Distance SL × Valeur du point)

### Exemple de calcul

- Capital : 10 000 €
- Risque : 1% = 100 €
- Distance SL : 50 points ( $2,5 \times \text{ATR} = 2,5 \times 20$ )
- Valeur du point EURUSD : 1 € (pour 0.01 lot)
- Taille recommandée :  $100 \text{ €} / (50 \times 1 \text{ €}) = 2 \text{ lots}$

# Optimisation

## Paramètres à tester

1. **ROC\_Period** : 10, 12, 14, 16
2. **ROC\_Threshold** : 1.5, 2.0, 2.5, 3.0
3. **ATR\_Multiplier** : 2.0, 2.5, 3.0
4. **EMA\_Period** : 50, 100, 200

## Méthode d'optimisation

1. **Forward analysis** : Optimiser sur 70% des données, tester sur 30%
2. **Walk-forward** : Optimisation glissante sur 6 mois, test sur 1 mois
3. **Métriques importantes** :
  - Profit Factor > 1.3
  - Drawdown maximum < 15%
  - Ratio de Sharpe > 1.0

## Périodes de marché

- **Trending markets** : Réduire ROC\_Threshold, augmenter EMA\_Period
- **Range markets** : Augmenter ROC\_Threshold, réduire ATR\_Multiplier
- **Volatile markets** : Augmenter ATR\_Multiplier, activer trailing stop

## Avertissements

### Risques généraux

#### ⚠ Le trading automatisé comporte des risques élevés de perte

- Les performances passées ne garantissent pas les résultats futurs
- L'EA peut subir des pertes consécutives importantes
- Les conditions de marché peuvent changer et affecter la stratégie
- Toujours tester en démonstration avant utilisation réelle

## Conditions de marché défavorables

- **News économiques** : Arrêter l'EA 30 min avant/après
- **Faible liquidité** : Éviter les sessions de fin de semaine
- **Spreads élevés** : L'EA s'arrête automatiquement si spread > MaxSpread
- **Forte volatilité** : Surveiller attentivement les positions

## Limitations techniques

- Requiert une connexion internet stable
- Sensible aux requotes et slippage
- Performance dépendante de la qualité des données historiques
- Peut nécessiter des ajustements selon le courtier

## Support et mises à jour

- Vérifiez régulièrement les mises à jour
  - Testez toujours les nouvelles versions en démonstration
  - Documentez vos paramètres optimisés
  - Conservez des sauvegardes de configuration
- 

## Informations légales

**Avis de non-responsabilité :** Ce logiciel est fourni “tel quel” sans garantie. L’utilisateur assume tous les risques liés au trading automatisé. Les auteurs ne peuvent être tenus responsables des pertes financières.

**Version :** 1.0

**Date :** Février 2024

**Compatibilité :** MetaTrader 5

---

*Pour toute question technique, consultez la documentation MetaTrader 5 ou contactez votre courtier.*